

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de diciembre de 2023
Fecha de Información: 21 de diciembre de 2023¹

Según el reporte de los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre Divisas del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1882 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.64%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	327,6	278,8	223,3	262,5	14,5	24,1	41
15-35	378,7	438,8	258,0	231,5	40,7	7,2	140
36-60	157,7	142,4	125,0	150,0	17,4	7,7	0
61-90	11,0	181,9	143,8	0,0	28,2	1,0	10
91-180	47,3	40,8	0,1	11,6	30,7	25,7	10
>180	39,9	37,6	34,8	37,4	2,8	2,4	0
Total	962,3	1120,3	784,9	693,1	134,4	68,2	201

^a Cifras en millones de dólares

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ^a	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	7.86%	7.05%	7.74%	7.45%
15-35	8.04%	8.01%	6.68%	7.61%
36-60	–	7.83%	7.76%	7.79%
61-90	7.81%	7.77%	7.49%	7.77%
91-180	7.66%	7.80%	7.62%	7.71%
>180	–	7.29%	6.55%	6.95%
Total	7.97%	7.73%	7.36%	7.64%

^a Incluye solo operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

¹A partir del 7 de diciembre se calcula este reporte incorporando la información preliminar reportada por los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre divisas al Banco de la República.

²El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	18 – 22 dic.				25 - 29 dic.				01 - 05 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	16	154	4443	4957	31	263	2981	3984	15	97	3701	5941
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2753	2315	0	0	2407	1798	0	0	4066	1971
Otros ^c	154	16	703	626	263	31	774	379	97	15	277	132
Total	170	170	7899	7898	294	294	6162	6161	112	112	8044	8044

^a Cifras en millones de dólares.

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.